

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 30.09.2018		Stratégie			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	7'055'111	0.8%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	148'368'545	15.8%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	129'333'300	13.8%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	64'646'861	6.9%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents (couvertes)	37'224'955	4.0%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	386'628'772	41.1%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	247'599'925	26.3%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	122'251'092	13.0%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	86'409'176	9.2%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	35'841'916	3.8%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde	98'595'986	10.5%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large et Mid Cap	88'883'276	9.5%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	9'712'710	1.0%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	26'752'847	2.8%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	55'529'382	5.9%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL	23'793'661	2.5%	1.0%	3.0%	5.0%		
CRIP	4'000'050	0.4%					
Matières premières	27'735'671	2.9%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	250'509'568	26.6%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	203'964'743	21.7%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	82'920'900	8.8%					
Indirect	121'043'843	12.9%					
Etranger (couvert)	46'544'825	5.0%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	553'638'875	58.9%		59.0%			
Total	940'267'647	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	125'348'833	13.3%	10.0%	15.0%	19.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	454'628'106	48.4%					
Couverture	329'279'273	35.0%					

Performances du portefeuille

2018

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/18	T2/18	juil. 18	août 18	sept. 18	T3/18	YTD 2018*
Portefeuille total	940.3	-1.30%	0.37%	1.14%	-0.67%	-0.06%	0.40%	-0.54%

* jusqu'au 30.09.2018

© PPCmetrics SA

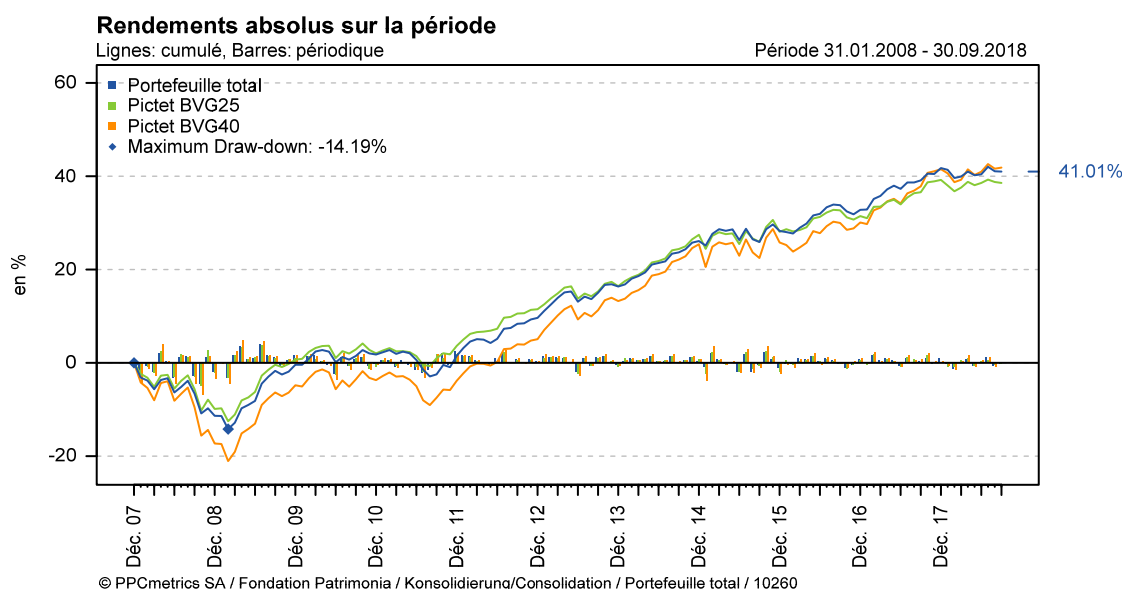
Depuis le début de la mesure de performance

	mio de CHF						YTD 2018*	Depuis le lancement		
		2013	2014	2015	2016	2017		cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	940.3	6.13%	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-0.54%	41.01%	3.25%	01.01.08

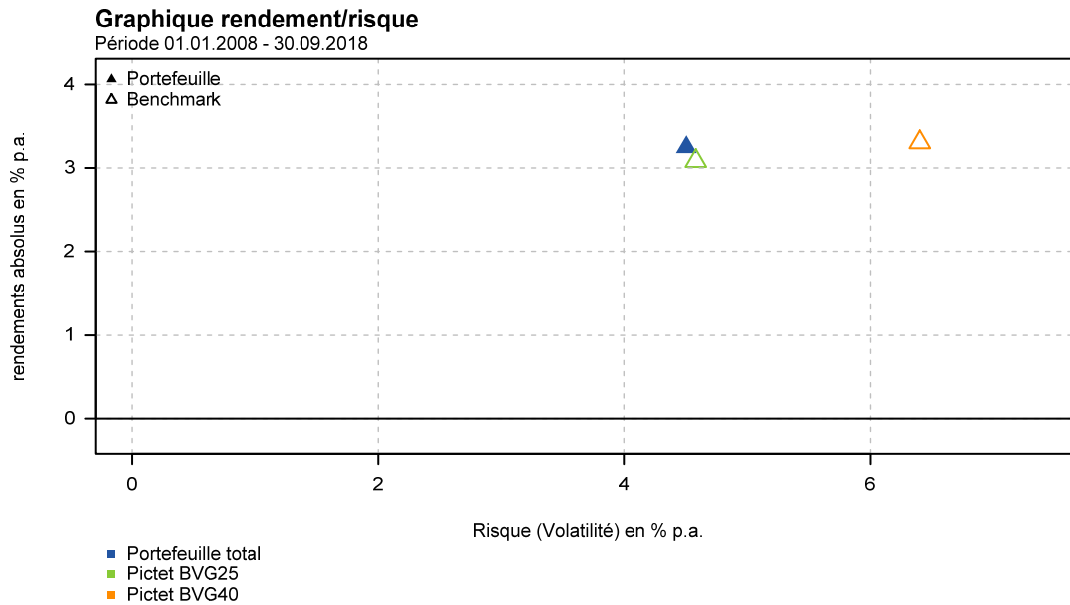
* jusqu'au 30.09.2018

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2018 au 30.06.2018)

